

## DAFTAR ISI

|                                                           |     |
|-----------------------------------------------------------|-----|
| HALAMAN PENGESAHAN.....                                   | ii  |
| HALAMAN PERNYATAAN .....                                  | iii |
| KATA PENGANTAR .....                                      | iv  |
| ABSTRAK.....                                              | vi  |
| ABSTRACT.....                                             | vii |
| DAFTAR TABEL, GAMBAR DAN RUMUS .....                      | x   |
| BAB I PENDAHULUAN .....                                   | 1   |
| 1.1. Gambaran Umum Objek Penelitian .....                 | 1   |
| 1.2. Latar Belakang .....                                 | 3   |
| 1.3. Rumusan Masalah .....                                | 6   |
| 1.4. Pertanyaan Penelitian .....                          | 6   |
| 1.5. Tujuan Penelitian .....                              | 6   |
| 1.6. Manfaat Penelitian .....                             | 7   |
| 1.7. Sistematika Pembahasan .....                         | 7   |
| 1.8. Ruang Lingkup Penelitian .....                       | 8   |
| BAB II LANDASAN TEORITIS .....                            | 9   |
| 2.1. Teori .....                                          | 9   |
| 2.1.1. Investasi .....                                    | 9   |
| 2.1.2. Pasar Efisien .....                                | 11  |
| 2.1.3. <i>Market Analysis</i> .....                       | 15  |
| 2.1.4. <i>Sentiment Analysis</i> .....                    | 16  |
| 2.1.5. <i>Big Data</i> .....                              | 17  |
| 2.1.6. <i>Data Mining</i> .....                           | 20  |
| 2.1.7. <i>Text Mining</i> .....                           | 23  |
| 2.1.8. <i>Natural Language Process</i> .....              | 23  |
| 2.1.9. <i>Machine Learning</i> .....                      | 26  |
| 2.1.10. Korelasi .....                                    | 27  |
| 2.1.11. Statistika Non-Parametrik .....                   | 28  |
| 2.1.12. Koefisien Korelasi Rank-Spearman .....            | 30  |
| 2.1.13. <i>Support Vector Machine (SVM)</i> .....         | 31  |
| 2.1.14. <i>Teorema Naïve Bayes Classifier (NBC)</i> ..... | 32  |
| 2.1.15. Penelitian Terdahulu .....                        | 32  |

|                                                              |    |
|--------------------------------------------------------------|----|
| 2.2. Kerangka Pemikiran.....                                 | 43 |
| BAB III METODE PENELITIAN.....                               | 45 |
| 3.1. Karakteristik Penelitian.....                           | 45 |
| 3.2. Alat Pengumpulan Data .....                             | 45 |
| 3.3. Variabel Operasional .....                              | 46 |
| 3.4. Tahapan Penelitian.....                                 | 47 |
| 3.5. Populasi dan Sampel .....                               | 50 |
| 3.5.1. Populasi.....                                         | 50 |
| 3.5.2. Sampel.....                                           | 51 |
| 3.6. Pengumpulan Data dan Sumber .....                       | 52 |
| 3.7. Teknik Analisis Data.....                               | 53 |
| 3.7.1. Pembersihan Dataset.....                              | 53 |
| 3.7.2. <i>Sentiment Analysis</i> .....                       | 53 |
| 3.7.3. Validasi dan Evaluasi Performa Klasifikasi Teks ..... | 62 |
| 3.7.4. Uji Koefisien Korelasi <i>Rank Spearman</i> .....     | 65 |
| 3.7.5. Eksplorasi Dinamika Harga Saham .....                 | 66 |
| BAB IV HASIL DAN PEMBAHASAN .....                            | 69 |
| 4.1. Karakteristik Data .....                                | 69 |
| 4.2. Hasil dan Pembahasan .....                              | 69 |
| 4.2.1. <i>Sentiment Analysis</i> .....                       | 70 |
| 4.2.2. Uji Korelasi <i>Rank-Spearman</i> .....               | 85 |
| 4.2.3. Dinamika Harga Saham .....                            | 86 |
| BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....                              | 89 |
| 5.1. Kesimpulan .....                                        | 89 |
| 5.2. Saran .....                                             | 89 |
| 5.2.2 Saran bagi Penelitian Selanjutnya.....                 | 90 |
| DAFTAR PUSTAKA .....                                         | 92 |
| LAMPIRAN I. STATISTIKA KORELASI <i>RANK SPEARMAN</i> .....   | L  |
| LAMPIRAN II. DATA <i>SENTIMENT ANALYSIS</i> .....            | U  |
| LAMPIRAN III. PROSES <i>SENTIMENT ANALYSIS</i> .....         | ZZ |